

Online /  CIIIC
Perú

PROGRAMA DE ESPECIALIZACIÓN ANÁLITICA

MARKET RISK ANALYTICS

BROCHURE 2023

#AprendeDesdeCasa
#AprendeConLosPioneros



PRESENTACIÓN

¿Alguna vez te has preguntado cómo las entidades financieras rentabilizan los fondos de ahorros que reciben? ¿O cómo determinan las tasas de interés de los productos que venden? Hoy en día cuentan con un equipo especializado de tesorería, el cual representa alrededor del 40% del ingreso cuantificable para la organización. Tanto en bancos, como en financieras y cajas se busca maximizar los ingresos provenientes de los activos de los clientes, para así rentabilizar las ganancias. El riesgo de todas estas actividades es controlado por equipos de Riesgo de Mercado.

En ese contexto, presentamos el **Programa de Especialización Market Risk Analytics**, en el cual se abordarán los principales conceptos para una correcta gestión de Riesgo de Mercado dentro del contexto internacional y local, alineado al marco de Basilea. Además, aprenderás a crear metodologías financieras basadas en Data Science y Market Risk- que permitan controlar y gestionar estos riesgos a través de una arquitectura tecnológica alineada a este fascinante mundo.

Pre-requisitos:

- Conocimientos básicos en Python.
- Conocimientos financieros básicos.
- Experiencia en banca (deseable).



Inicio: 27/04/23 - Fin: 05/10/23



164 horas académicas



Martes y jueves de 7:30pm a 10:30pm

OBJETIVOS



Objetivo General

Conocer a detalle la gestión de Riesgo de Mercado en todos sus tipos: ALM, Trading y contraparte, Liquidez, IFRS9; así como aprender las principales metodologías financieras que dan soporte a esta gestión a través de una arquitectura tecnológica innovadora y de acuerdo con la realidad peruana.



Objetivos Específicos

- > Comprender las metodologías y herramientas asociadas a la gestión de riesgos financieros y riesgos de mercado.
- > Gestionar y diseñar arquitecturas orientadas a la gestión de riesgo estructural de tasas de interés y riesgos de liquidez.
- > Aplicar metodologías para el riesgo de crédito de inversiones e interacción con la normativa contable NIIF9.



Competencias:

Al finalizar el programa, el participante estará en capacidad de:

- > Describir e interpretar las principales definiciones de Riesgos de Mercado, financieros, Trading y sus metodologías; así como comprender, configurar y usar las principales bases de datos relacionales y no relacionales.
- > Gestionar el riesgo estructural de tasas de interés y describir los principales conceptos de riesgo de liquidez y su metodología.
- > Usar metodologías para el cálculo de riesgo de crédito de inversiones e interacción con normativa contable NIIF9.
- > Construir un modelo de Riesgo de Mercado a través de un caso práctico.

Dirigido a:

- > Profesionales interesados en áreas de Riesgo de Mercado con perfiles de estadística, economía, ingeniería de sistemas, entre otros.
- > Profesionales de diversas áreas con conocimientos básicos en Finanzas y con interés de conocer cómo se construyen e implementan los modelos de Riesgo de Mercado.

CARACTERÍSTICAS

Clases en Vivo

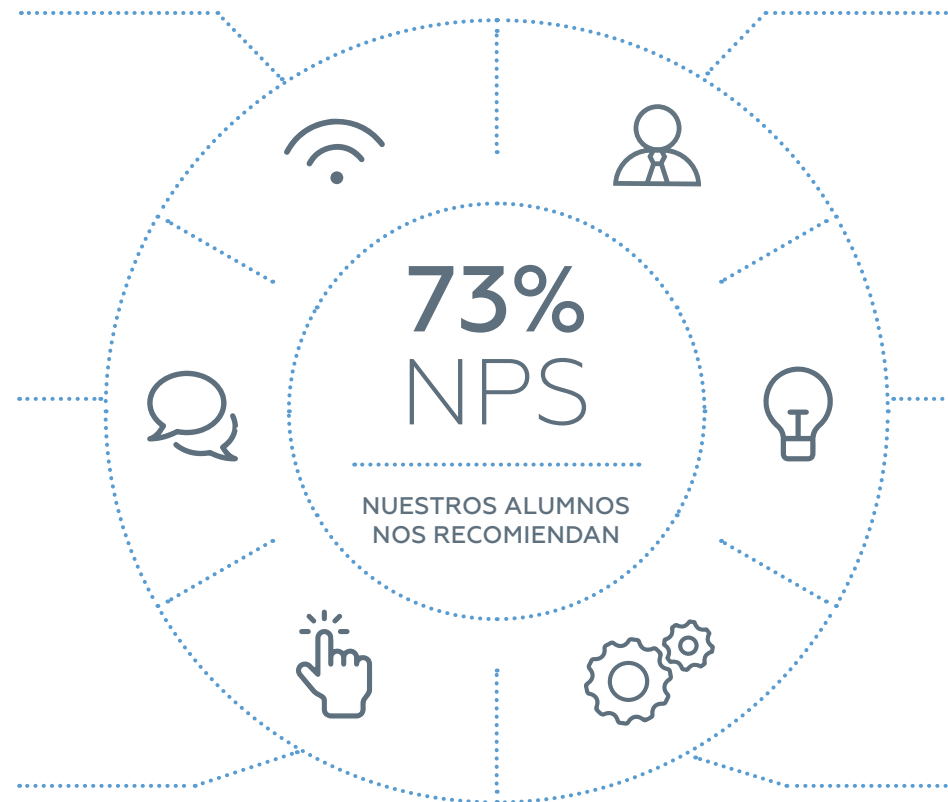
El 100% de las clases que se desarrollan en el programa son en vivo.

Asesoría Académica

Resuelve tus dudas con el asistente académico en línea.

Plataforma E-Learning

Accede en cualquier momento a materiales complementarios: lecturas, videos, tutoriales, clases grabadas y más.



Aprende haciendo

Desarrolla casos con datos reales, incluso puedes proponer casos de tu propio sector.

Proyecto integrador

Pondrás a prueba tus ideas para convertirlas en soluciones analíticas.

Soporte técnico

Asistencia técnica permanente y acceso a máquinas virtuales de ser necesario.

PROGRAMA CURRICULAR



Taller de socialización

4 horas académicas



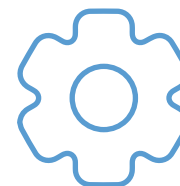
Administración de Riesgos y Regulación Financiera

8 horas académicas



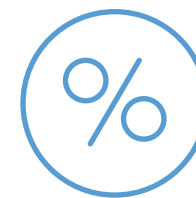
Introducción al Riesgo de Mercado

20 horas académicas



Herramientas de gestión del riesgo de mercado

20 horas académicas



Riesgo estructural de tasas de interés

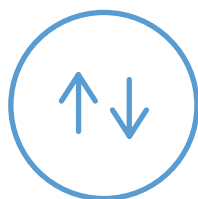
28 horas académicas

RIESGO DE MERCADO



Riesgo de liquidez

20 horas académicas



Arquitectura de una solución ALM

12 horas académicas



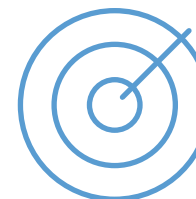
Riesgo de crédito de las inversiones

20 horas académicas



Riesgo de contraparte

20 horas académicas



Construcción de un modelo

12 horas académicas

R. ESTRUCTURAL, TASAS DE INTERÉS Y LIQUIDEZ

R. DE CRÉDITO DE INVERSIONES Y CONTRAPARTE

TALLER INTEGRADOR



Administración de Riesgos y Regulación Financiera

Conoce las principales definiciones de riesgos financieros y riesgo de Mercado.

- Introducción a la Administración de Riesgos.
- Importancia de una gestión de Riesgo de Mercado en el sector Financiero.
- Los tipos de Riesgo de Mercado.
- Marco de Basilea (1,2,3) y su relevancia en la política de Riesgo de Mercado en entidades financieras.



Introducción al Riesgo de Mercado

Aprende los principales conceptos del riesgo de Trading y sus metodologías.

- ¿Qué significa realizar trading?
- Instrumentos Financieros: Bonos, Derivados: Forwards y Swaps.
- Riesgo Total de un portafolio.
- Value at Risk (VAR) y Metodología.
- Estrés Test.
- BackTesting.



Herramientas de Gestión del Riesgo de Mercado

Configura y aplica software orientado a la gestión de riesgo de mercado.

- Arquitectura de una solución para gestionar riesgo de trading.
- Factores de Riesgo y su integración en un modelo de trading.
- Proveedores de Precio: Bloomberg, Reuters y otros.
- Creación de Vector de Precios de Mercado.



Riesgo Estructural de Tasas de Interés

El módulo le permitirá al participante gestionar el Riesgo Estructural de Tasas de Interés.

- Introducción al Riesgo de ALM/ tasas y principales definiciones.
- Gestión estratégica de activos y pasivos.
- Gap de tasas de interés.
- Métricas de sensibilidad de valor económico.
- Métricas de sensibilidad de Margen Financiero.
- Modelos Conductuales.
- Calibración de Modelos Conductuales.
- Optimización de Balance.



Riesgo de Liquidez

Conoce los conceptos y metodologías de riesgo de liquidez.

- Introducción al Riesgo de Liquidez.
- Gestión de Liquidez y construcción de GAP de Liquidez.
- Ratio de Cobertura de Liquidez.
- Ratio de Fondeo Neto Estable.
- Estrategia de Optimización de Pasivos y de Portafolio de activos líquidos.
- Escenarios de estrés de liquidez y diseño del plan de contingencia de Liquidez.
- Riesgo de Liquidez de Negociación (Trading Liquidity Risk).



Arquitectura de una solución ALM

Diseña una arquitectura para la gestión de tasas de interés y liquidez.

- Diseño de una arquitectura para gestionar riesgo de tasas y liquidez.
- Estrategia de datos para capturar los activos de una organización.
- Definir la granularidad de los productos bancarios: Producto y operación.
- Software y plataformas en el mercado.
- Creación de cubos para la correcta medición del riesgo de tasas de interés y liquidez.



Riesgo de crédito de las inversiones

Metodologías para el riesgo de crédito de inversiones e interacción con normativa contable NIIF9.

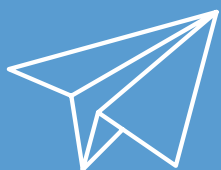
- Introducción de NIIF9: Creditos y Mercado.
- Cálculo de PD, LGD y EAD para contrapartes de Riesgo de Mercado.
- Aplicación metodológica y análisis por Stage Definido.



Riesgo de Contraparte

Diseña modelos de evaluación de tiempo de vida con Machine L. y análisis de supervivencia.

- Introducción al riesgo de contraparte de derivados y los factores que afectan.
- Gestión de colaterales.
- Cobertura sobre los factores de mercado.
- Ajuste de valor de la deuda (DVA).
- Metodología para el cálculo de CVA bajo el portafolio de SWAP, FWD y futuros.



TALLER INTEGRADOR

Construcción de un modelo de riesgo de mercado

.....

El módulo le permitirá al participante aplicar lo aprendido construyendo un modelo de riesgo de mercado a través de un caso práctico.



EVALUACIÓN

- + Evaluaciones parciales: 40%
- + Trabajo final 60%
- + Nota mínima aprobatoria: 14
- + Asistencia mínima: 80%



CERTIFICACIÓN

CERTIFICADOS PARCIALES:

- + Especialista en Riesgo de Mercado. 48 horas acad.
 - + Esp. en Riesgo Estructural / Tasas de Interés y Liquidez. 60 horas acad.
 - + Riesgo de Crédito de Inversiones / Riesgos de Contraparte. 40 horas acad.
-

CERTIFICADO FINAL:

- + Especialista en Market Risk Analytics. 164 horas académicas.

* Todos los certificados se emitirán de forma digital luego de concluido el programa.

PLANA DOCENTE



**MARIANA
ALVA**

Product Owner
Riesgos de Mercado



EXPERIENCIA:



Subgerente Ingeniería Financiera Riesgo de Mercado (Jun 2021 – Feb 2022)

Subgerente Adjunto TI Riesgos de Mercado (Feb 2019 – May 2021)



Analista de Eficiencia Activación de Tarjetas (Feb 2017 – Nov 2017)

Asistente de Tesorería en Mercado de Capitales (Jul 2015 – Ene 2017)



**BRANGOVICH
ORDOÑEZ**

Head of Financial
Engineer



EXPERIENCIA:



Gerente adjunto Riesgos de Mercado Tecnología (Ene 2019 – May 2021)

Subgerente Riesgos de Mercado Tecnología (Oct 2017 – Dic 2018)



Analista Sr. de Diseño e Ingeniería Operacional (Ene 2017 – Jun 2017)

Analista Sr. de Banca Retail (Ene 2016 – Dic 2016)



**EDWARD
SÁNCHEZ**

Gerente de Riesgos de
Liquidez y Tasas



EXPERIENCIA:



Gerente Adjunto de Riesgos de Mercado (Ene 2020 – Nov 2021)

Subgerente de Riesgos de Mercado (Mar 2018 – Dic 2019)



Analista Senior de Riesgos de Inversión (Mar 2015 – Feb 2017)

Analista de Riesgos de Inversión (Mar 2013 – Feb 2015)

*En caso de contingencias podría cambiar alguno de los docentes por otro profesional de similar perfil.

Buscamos liderar la transformación de las empresas.



+14

Años de Experiencia

Desde el año 2009 capacitamos con técnicas de análisis de datos a profesionales de diferentes empresas y sectores.



+15K

Profesionales Capacitados

Nuestros alumnos inscritos pertenecen a las mejores compañías del medio y amplifican con nosotros su red de contactos especializada.



+300

Empresas Asesoradas

Las empresas top del mercado buscan nuestra asesoría y les brindamos soluciones analíticas ad hoc.



Formando profesionales mediante la analítica de los datos.

+100

Expertos en Analítica

Nuestra plana docente ocupa los cargos más importantes en las áreas analíticas de todos los sectores.



+50

Capacitaciones Especializadas

Contamos con una variedad de líneas temáticas y niveles de especialización.



+5

Big Data Analytics Summit

Organizamos el evento más grande del Perú, con los mejores ponentes internacionales.



